



Rat der
Europäischen Union

Brüssel, den 8. Juni 2016
(OR. en)

10068/16
ADD 1

EF 182
ECOFIN 588
DELECT 110

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag des Generalsekretärs der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	8. Juni 2016
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union
Nr. Komm.dok.:	C(2016) 3337 final ANNEXES 1 to 2
Betr.:	ANHÄNGE zur DELEGIERTEN VERORDNUNG DER KOMMISSION zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die jährliche Veröffentlichung von Informationen durch Wertpapierfirmen zur Identität von Handelsplätzen und zur Qualität der Ausführung

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2016) 3337 final ANNEXES 1 to 2.

Anl.: C(2016) 3337 final ANNEXES 1 to 2



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 8.6.2016
C(2016) 3337 final

ANNEXES 1 to 2

ANHÄNGE

zur

DELEGIERTEN VERORDNUNG DER KOMMISSION

zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die jährliche Veröffentlichung von Informationen durch Wertpapierfirmen zur Identität von Handelsplätzen und zur Qualität der Ausführung

ANHÄNGE

Anhang I: Kategorien von Finanzinstrumenten

- a) Eigenkapitalinstrumente – Aktien und Aktienzertifikate
 - i) Tick-Größe/Liquiditätsbänder 5 und 6 (ab 2000 Geschäften pro Tag)
 - ii) Tick-Größe/Liquiditätsbänder 3 und 4 (zwischen 80 und 1999 Geschäften pro Tag)
 - iii) Tick-Größe/Liquiditätsbänder 1 und 2 (zwischen 0 und 79 Geschäften pro Tag)
- b) Schuldtitel
 - i) Schuldverschreibungen
 - ii) Geldmarktinstrumente
- c) Zinsderivate
 - i) Terminkontrakte und Optionskontrakte, die für den Handel auf Handelsplätzen zugelassen sind
 - ii) Swaps, Termingeschäfte und sonstige Zinsderivate
- d) Kreditderivate
 - i) Terminkontrakte und Optionskontrakte, die für den Handel auf Handelsplätzen zugelassen sind
 - ii) Sonstige Kreditderivate
- e) Währungsderivate
 - i) Terminkontrakte und Optionskontrakte, die für den Handel auf Handelsplätzen zugelassen sind

- ii) Swaps, Termingeschäfte und sonstige Währungsderivate
- f) Strukturierte Finanzprodukte
- g) Aktienderivate
 - i) Optionskontrakte und Terminkontrakte, die für den Handel auf Handelsplätzen zugelassen sind
 - ii) Swaps und sonstige Aktienderivate
- h) Verbriefte Derivate
 - i) Optionsscheine und Zertifikate
 - ii) Sonstige verbrieft Derivate
- i) Rohstoffderivate und Derivate von Emissionszertifikaten
 - i) Optionskontrakte und Terminkontrakte, die für den Handel auf Handelsplätzen zugelassen sind
 - ii) Sonstige Rohstoffderivate und Derivate von Emissionszertifikaten
- j) Differenzgeschäfte
- k) Börsengehandelte Produkte (börsengehandelte Fonds, börsengehandelte Schuldverschreibungen und börsengehandelte Rohstoffprodukte)
- l) Emissionszertifikate
- m) Sonstige Instrumente

Tabelle 1

Kategorie des Finanzinstruments					
Angabe, ob im Vorjahr im Durchschnitt < 1 Handelsgeschäft pro Geschäftstag ausgeführt wurde	J/N				
Die fünf Handelsplätze, die ausgehend vom Handelsvolumen am wichtigsten sind (in absteigender Reihenfolge nach Handelsvolumen)	Anteil des Handelsvolumens als Prozentsatz des gesamten Volumens in dieser Kategorie	Anteil der ausgeführten Aufträge als Prozentsatz aller Aufträge in dieser Kategorie	Prozentsatz passiver Aufträge	Prozentsatz aggressiver Aufträge	Prozentsatz gelenkter Aufträge
Name und Kennung (MIC oder LEI)					
Name und Kennung (MIC oder LEI)					
Name und Kennung (MIC oder LEI)					
Name und Kennung (MIC oder LEI)					
Name und Kennung (MIC oder LEI)					

Tabelle 2

Kategorie des Finanzinstruments					
Angabe, ob im Vorjahr im Durchschnitt <1 Handelsgeschäft pro Geschäftstag ausgeführt wurde	J/N				
Die fünf Handelsplätze, die ausgehend vom Handelsvolumen am wichtigsten sind (in absteigender Reihenfolge nach Handelsvolumen)	Anteil des Handelsvolumens als Prozentsatz des gesamten Volumens in dieser Kategorie	Anteil der ausgeführten Aufträge als Prozentsatz aller Aufträge in dieser Kategorie	Prozentsatz passiver Aufträge	Prozentsatz aggressiver Aufträge	Prozentsatz gelenkter Aufträge
Name und Kennung (MIC oder LEI)					
Name und Kennung (MIC oder LEI)					
Name und Kennung (MIC oder LEI)					
Name und Kennung (MIC oder LEI)					
Name und Kennung (MIC oder LEI)					

Tabelle 3

Kategorie des Finanzinstruments	Ja/Nein	
Angabe, ob im Vorjahr im Durchschnitt <1 Handelsgeschäft pro Geschäftstag ausgeführt wurde		
Die fünf Handelsplätze, die ausgehend vom Handelsvolumen am wichtigsten sind (in absteigender Reihenfolge nach Handelsvolumen)	Anteil des Handelsvolumens als Prozentsatz des gesamten Volumens in dieser Kategorie	Anteil der ausgeführten Aufträge als Prozentsatz aller Aufträge in dieser Kategorie
Name und Kennung (MIC oder LEI)		
Name und Kennung (MIC oder LEI)		
Name und Kennung (MIC oder LEI)		
Name und Kennung (MIC oder LEI)		
Name und Kennung (MIC oder LEI)		